

Fecha de Publicación: 8 de Julio de 2009
Fecha de Información: 06 de Julio de 2009 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$659,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	168,5	125,6	30,0	0,0	75,6	148,5	274,1
15-35	156,4	209,2	117,2	37,0	66,0	93,4	339,6
36-60	4,2	34,3	0,0	0,0	34,3	4,2	38,6
61-90	3,9	0,0	0,0	0,0	0,0	3,9	3,9
91-180	0,4	0,3	0,0	0,0	0,3	0,4	0,7
>180	0,0	3,0	0,0	0,0	3,0	0,0	3,0
Total	333,4	372,4	147,2	37,0	179,2	250,4	659,8

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,5 %	6,1 %	5,4 %	5,6 %
15-35	5,3 %	5,9 %	4,8 %	5,4 %
36-60	-	5,9 %	4,9 %	5,8 %
61-90	-	-	4,5 %	4,5 %
91-180	-	5,6 %	4,4 %	4,9 %
>180	-	5,7 %	-	5,7 %
Total	4,9 %	6,0 %	5,1 %	5,5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	6 al 10 de Julio				13 al 17 de Julio				20 al 24 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	30	1800	1841	13	35	1393	1248	1	25	783	1057
Intragrupa y off-shore***	0	0	1162	580	0	0	643	299	0	0	765	223
Otros	30	11	319	859	35	13	393	881	25	1	184	452
Total	40	40	3281	3281	48	48	2428	2428	27	27	1732	1732

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo